

## 泰信双息双利债券型证券投资基金2019年第3季度报告

2019年9月30日

信披义务人：泰信基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
报告送出日期：2019年10月26日

## § 1 重要提示

本基金的董事、监事及高级管理人员根据《基金法》和《信息披露办法》的有关规定，保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的基金管理人（即中国工商银行股份有限公司）承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

基金合同生效时间为2019年7月1日至2019年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 泰信双息双利债券

交易代码 200003

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2007年10月31日

报告期末基金份额总额 42,467,004.09份

投资目标 本基金的投资目标是在获取稳定收益的基础上，通过股票一级市场和二级市场的操作，获取股票投资的超额收益，从而实现基金资产的保值增值。

投资策略 本基金的投资策略如下：

1) 在不同的经济周期中，根据宏观经济形势、货币政策、行业政策、资金面等对股票市场的判断，适时调整股票仓位。

2) 从企业的质地方面选择行业、证券从业人员按照管理办法的有关规定，对本基金所持有的股票进行定期或不定期的评估。

3) 本基金的业绩比较基准为：业绩比较基准=上证综合指数×40%+短期国债收益率×60%。

业绩比较基准 本基金的业绩比较基准上证综合指数。

风险收益特征 风险收益特征：本基金为债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币市场基金。

基金经理 泰信基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2019年7月1日 - 2019年9月30日)

1.本期已实现收益 615,907.20

2.本期利润 616,197.94

3.加权平均基金份额本期利润 0.0143

4.期末基金份额净值 44,882,000.00

5.期末基金份额净值 1.0097

1.本期已实现收益金额计入收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动收益）扣除和弃用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本期利润金额不包括持有人申购或赎回本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示数据。

3.2本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.27% 0.12% 1.28% 0.02% -0.01% 0.10%

本基金业绩比较基准：业绩比较基准。

3.2.1本基金转型以来基金经理变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.2本基金转型以来基金经理变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.27% 0.12% 1.28% 0.02% -0.01% 0.10%

1.本期已实现收益金额计入收入，投资收益，其他收入（不含公允价值变动收益）扣除和弃用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本期利润金额不包括持有人申购或赎回本基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列示数据。

3.2.3本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.4本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.5本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.6本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.7本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.8本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.9本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.10本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.11本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.12本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.13本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.14本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.15本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.16本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.17本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.18本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.19本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.20本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.21本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.22本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.23本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.24本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.25本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.26本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.27本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率差额(%) 标准差(%)  
① -③ ② -④

过去三个月 1.23% 0.21% 1.02% 0.02% -0.01% 0.10%

3.2.28本基金报告期内基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 业绩比较基准